

Berechnung CVA



Fonds: 2496T2 Capitulum Weltzins-Invest Universal AK I
Währung: EUR
ISIN: DE000A2H7NU1
LEI: 529900Q626RC55DLB570
Fondsvermögen: 268.731.980,05
Anteile in Umlauf: 3.211.098

Auswertung per: 20.1.2026 23:45
Bewertungsdatum: 20.1.2026 23:45

Kontrahent ID	Kontrahent	Kontrahent-LEI	KSA Bonitätsstufe Kontrahent	Risikogewicht je Kontrahent (RW)	Standard CVA-Risiko SCVA	Term 1 Fonds (Zwischenergebnis)	Term 2 Fonds (Zwischenergebnis)	CVA-Risiko im Rahmen des Basisansatzes - unhedged BACVA	CVA-Risiko im Rahmen des Basisansatzes - total BACVA	total BACVA in % FV	Zielfonds Anzahl Gegenparteien
871001	BNP Paribas S.A.	R0MUWSFPU8MPRO8K5P	2	5,00	13.819,48	1.054.103.725,21	2.102.748.748,49	36.520,82	36.520,82	0,01	0
805250	J.P. Morgan SE	549300ZK53CNGEEI6A29	1	5,00	51.114,45	1.054.103.725,21	2.102.748.748,49	36.520,82	36.520,82	0,01	0
Total								36.520,82	36.520,82	0,01	
								davon OTC:		1.652.400,94	0,61

Fondsvolumen inkl. Forderungen	268.731.980,05
- Fondsvolumen aus Bewertung	268.731.980,05
Differenz	-0,00

CVA-Risiko Betrag aus OTC-Derivaten	in % <u>Formular C25.01</u>	268.731.980,05 default: Marktwert des Fonds --> mit Buchwert überschreiben
Betrag Summe der Risikopositionswerte (OTC-Derivate mit CVA-Charge)	0,01 Zeile 20; Spalte 70	Betrag in Buchwert:
Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteiausfallrisiko der OTC-Derivate mit CVA-Relevanz	0,61 Zeile 20; Spalte 10	36.520,68
Betrag Nominalbetrag CVA-Geschäfte	0,14 Zeile 20; Spalte 20	1.652.400,70
	7,52 Zeile 20; Spalte 30	367.638,79
		20.196.887,24
ZUSATZINFORMATIONEN:		
Gruppeninterne Geschäft: CVA-Risiko Betrag aus OTC-Derivaten	0,00 Zeile 40 u. 90; Spalte 70	-
Gruppeninterne Geschäft: Betrag Summe der Risikopositionswerte	0,00 Zeile 40 u. 90; Spalte 10	-
Gruppeninterne Geschäft: Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteiausfallrisiko	0,00 Zeile 40 u. 90; Spalte 20	-
CVA-Risiko Betrag aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften	0,00 Zeile 130; Spalte 70	-
Betrag Summe der Risikopositionswerte (Wertpapierfinanzierungsgeschäfte mit CVA-Charge)	0,00 Zeile 130 Spalte 10	-
Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteiausfallrisiko der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte mit CVA-Relevanz	0,00 Zeile 130; Soalte 20	-